

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

更新招募说明书摘要

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金合同于 2014 年 05 月 09 日经中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，基金合同自该日起正式生效。

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

重要提示

本基金根据【2013】年【11】月【21】日中国证券监督管理委员会《关于核准东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2013】1471 号）注册募集。

基金管理人保证《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。从整体运作来看，基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。从两类份额看，可转债 A 份额持有人的年化约定收益率为一年期定期存款利率（税后）+3.00%，表现出预期风险较低、预期收益相对稳定的特点。可转债 B 份额获得剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出预期风险较高，预期收益相对较高的特点。

本基金投资范围包括中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。相对而言，中小企业私募债券存在较高的流动性风险和信用风险。尽管本基金将中小企业私募债券的投资比例控制在一定的范围内，但仍然提请投资者关注中小企业私募债存在的上述风险及其对基金总体风险的影响。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2015 年 5 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

- 1、名称：东吴基金管理有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)
- 3、办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号(200135)
- 4、法定代表人：任少华
- 5、设立日期：2004 年 9 月 2 日
- 6、批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2003】82 号
- 7、组织形式：有限责任公司（国内合资）
- 8、注册资本：1 亿元人民币
- 9、联系人：钱巍
- 10、电话：(021) 50509888
- 11、传真：(021) 50509884
- 12、客户服务电话：400—821—0588（免长途话费）、021-50509666
- 13、公司网址：www.scfund.com.cn
- 14、股权结构：

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	7000	70%
上海兰生（集团）有限公司	3000	30%
合 计	10,000	100%

东吴基金管理有限公司设立基金投资总部、专户业务事业部、研究策划部、集中交易室、营销管理部、北京营销中心、上海营销中心、广州营销中心、苏州分公司、产品策略部、营

销策划部（加挂电子金融部）、总经理办公室、人力资源部、基金事务部、信息技术部、财务管理部、监察稽核部、风险管理部、北京办事处等 19 个职能部门。公司已管理的第一只产品东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金，于 2005 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第二只产品东吴价值成长双动力股票型证券投资基金，于 2006 年 12 月 15 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第三只产品东吴行业轮动股票型证券投资基金，于 2008 年 4 月 23 日基金合同生效，托管行为华夏银行股份有限公司。公司已管理的第四只产品东吴优信稳健债券型证券投资基金，于 2008 年 11 月 5 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第五只产品东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金，于 2009 年 5 月 6 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第六只产品东吴新经济股票型证券投资基金，于 2009 年 12 月 30 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第七只产品东吴货币市场证券投资基金，于 2010 年 5 月 11 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第八只产品东吴新创业股票型证券投资基金，于 2010 年 6 月 29 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第九只产品东吴中证新兴产业指数证券投资基金，于 2011 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十只产品东吴增利债券型证券投资基金，于 2011 年 7 月 27 日基金合同生效，托管行为中信银行股份有限公司。公司已管理的第十一只产品东吴新产业精选股票型证券投资基金，于 2011 年 9 月 28 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十二只产品东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF），于 2012 年 3 月 9 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十三只产品东吴保本混合型证券投资基金，于 2012 年 8 月 13 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十四只产品东吴内需增长混合型证券投资基金，于 2013 年 1 月 30 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十五只产品东吴鼎利分级债券型证券投资基金，于 2013 年 4 月 25 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十六只产品东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金，于 2014 年 3 月 19 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十七只产品东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金，于 2014 年 5 月 9 日基金合同生效，托管行为平安银行股份有限公司。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

吴永敏先生，董事长，硕士研究生，高级审计师、高级经济师，中共党员。历任苏州市财政局科员、苏州市税务局副科长、苏州市税务局三分局局长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长，东吴证券股份有限公司董事长、党委书记，现任东吴基金管理有限公司董事长。

金燕萍女士，副董事长，大学，高级政工师，中共党员。历任上海外贸总公司党委委员、党委办公室副主任，上海海外公司党总支书记，上海广告公司党委副书记、副总经理，上海实业（集团）有限公司办事处常务副主任、党总支书记、上海兰生（集团）有限公司总裁助理、投资管理部总经理。

任少华先生，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任苏州市人民检察院助理检查员，苏州中辰期货公司总经理助理，苏州证券投资部总经理、资产管理部总经理、副总经济师，东吴证券股份有限公司资产管理总部总经理、总经济师、总裁助理兼任期货筹备组组长、研究所所长，东吴证券股份有限公司党委委员、副总裁，东吴期货有限公司董事长。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁，东吴证券总规划师兼研究所所长，现任东吴证券股份有限公司总规划师兼资产管理总部总经理。

戴继雄先生，董事，硕士，历任上海复星高科技（集团）有限公司财务、审计副总监、上海兰生（集团）有限公司财务副总监、财务金融部总经理。现任上海五金矿产发展有限公司副总经理。

王炯先生，职工董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理。现任东吴基金管理有限公司常务副总经理兼产品策略部总经理。

贝政新先生，独立董事，大学，教授，博士生导师。历任苏州大学商学院财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授。

张平先生，独立董事，教授，博士生导师。历任中国社科院经济研究所研究员、所长助理，现任中国社科院经济研究所副所长。

陈如奇先生，独立董事，大专学历，中共党员，高级经济师。历任新疆人民银行巴州中心支行科员，新疆农业银行巴州及自治区分行科长、处长，交通银行上海分行处长、副行长，交通银行广州分行行长，交通银行香港分行总经理等职。

2、监事会成员

顾锡康先生，监事会主席，硕士学位，高级工程师、经济师，中共党员。历任苏州电子计算机厂工程师、室主任，苏州人民银行科技科硬件组组长，苏州证券电脑中心经理、技术总监，东吴证券技术总监兼信息技术总部总经理，东吴证券股份有限公司合规总监、监事会主席。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵，员工监事，本科，学士学位，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理，现任监察稽核部总经理兼风险管理部总经理。

3、高管人员

吴永敏先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

任少华先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

王炯先生，常务副总经理、硕士研究生，经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员、苏州证券西北街营业部业务主管、东吴证券办公室副主任、总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理等职务，现任东吴基金管理有限公司常务副总经理兼产品策略部总经理。

徐军女士，督察长，大学，会计师、审计师，中共党员。历任苏州市审计局财政、金融审计处科员、副处长，东吴证券财务部总经理，东吴基金管理有限公司财务负责人、公司总裁助理等职务，现任东吴基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

现任基金经理：

杨庆定，博士，上海交通大学管理学专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理；2007年7月至2010年6月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理；2013年4月再次加入东吴基金管理有限公司，现担任公司基金投资总部总经理，其中自2013年6月25日起担任东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理、自2014年5月9日起担任东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金基金经理、自2014年6月28日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、自2014年6月28日起担任东吴保本混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

程 涛 公司总经理助理兼首席投资官、专户业务事业部总经理；

杨庆定 基金投资总部总经理；

陈 宪 研究策划部总经理；

戴 斌 基金投资总部副总经理；

王立立 基金投资总部副总经理；

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基本情况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：孙建一

成立日期：1987年12月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：5,123,350,416元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：李玉彬

联系电话：(0755) 2216 8677

平安银行股份有限公司（简称：平安银行，股票简称：平安银行，股票代码：000001）是由原深圳发展银行股份有限公司以吸收合并原平安银行股份有限公司的方式完成两行整合更名而来，是中国内地首家向公众发行股票并公开上市的全国性股份制商业银行，总部设于深圳。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行股份约 67.34 亿股，约占平安银行总股本的 59%，为平安银行的控股股东。截至 2014 年 12 月末，本行资产总额 21,864.59 亿元，较年初增长 15.58%；各项存款余额 15,331.83 亿元，较年初增加 3,161.81 亿元，增幅 25.98%，增量为上年全年增量的 1.6 倍，增速居同业领先地位，市场份额提升；各项贷款（含贴现）余额突破万亿，达 10,247.34 亿元，较年初增幅 20.94%；营业收入 734.07 亿元，同比增长 40.66%，其中非利息净收入 203.61 亿元，同比增长 77.04%；

准备前营业利润 412.57 亿元，同比增长 53.69%；净利润 198.02 亿元，同比增长 30.01%；根据中国银监会《商业银行资本管理办法（试行）》计算的资本充足率 10.86%、一级资本充足率 8.64%、核心一级资本充足率 8.64%，满足监管标准。

截至 2014 年 12 月 31 日，平安银行在全国 43 个主要城市拥有共计 747 家网点，基本形成对东北、华北、华东、华南、中部、西南和西北地区的全面覆盖，并在香港设有代表处，分别为公司、零售和政府部门等客户提供多种金融服务。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展处、创新发展处、估值核算处、资金清算处、规划发展处、IT 系统支持处、督察合规处、外包业务中心 8 个处室，目前部门人员为 53 人。

2、主要人员情况

陈正涛，男，中共党员，经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家，具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作，具有本外币资金清算，银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985 年 7 月至 1993 年 2 月在武汉金融高等专科学校任教；1993 年 3 月至 1993 年 7 月在招商银行武汉分行任客户经理；1993 年 8 月至 1999 年 2 月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理；1999 年 3 月—2000 年 1 月在招行武汉分行青山支行任行长助理；2000 年 2 月至 2001 年 7 月在招行武汉分行公司银行部任副总经理；2001 年 8 月至 2003 年 2 月在招行武汉分行解放公园支行任行长；2003 年 3 月至 2005 年 4 月在招行武汉分行机构业务部任总经理；2005 年 5 月至 2007 年 6 月在招行武汉分行硚口支行任行长；2007 年 7 月至 2008 年 1 月在招行武汉分行同业银行部任总经理；自 2008 年 2 月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理，一直负责公司银行产品开发与管理，全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理，尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011 年 12 月任平安银行资产托管部副总经理；2013 年 5 月起任平安银行资产托管事业部副总裁（主持工作）；2015 年 3 月 5 日起任平安银行资产托管事业部总裁。

3、基金托管业务经营情况

2008 年 8 月 15 日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务。

截至 2015 年 3 月底，平安银行股份有限公司托管净值规模合计 2.01 万亿，托管证券投资基金共 17 只，具体包括华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富量子生命力股票型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、招商保证金快线货币市场基金、平安大华日增利货币市场基金、新华一路财富灵活配置混合型证券投资基金、新华阿里一号保本

混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、平安大华财富宝货币市场基金、红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华财富金 30 天理财债券型证券投资基金、新华活期添利货币市场证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、新华阿鑫一号保本混合型证券投资基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、鹏华安盈宝货币市场基金和平安大华新鑫先锋混合型证券投资基金。

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

1. 直销机构:

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址: 上海市浦东新区源深路 279 号 (200135)

办公地址: 上海市浦东新区源深路 279 号 (200135)

法定代表人: 任少华

联系人: 钱巍

直销电话: (021) 50509880

传真: (021) 50509884

客户服务电话: 400-821-0588 (免长途话费)、(021) 50509666

网站: www.scfund.com.cn

2. 场外代销机构:

(1) 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人: 田国立

联系人: 郭伟

电话: 010-65557048

传真: 010-65550827

客服电话: 95558

公司网址: <http://bank.ecitic.com>

(2) 交通银行股份有限公司

注册地址: 上海市银城中路 188 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

联系人: 曹榕

电话: 021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(3) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：(0755)83198888

传真：(0755) 83195049

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(4) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服电话：40066-99999（免长途费）0755-961202

公司网址：www.pingan.com

(5) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

客服电话：0577-96699

公司网址：www.wzbank.cn

(6) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-33396288

公司网址：www.dwzq.com.cn

(7) 申万宏源证券股份有限公司

注册地址：上海徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

(8) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：(010) 65183880

传真：(010) 65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(9) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(10) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：400 888 5288

公司网址：www.glsc.com.cn

（11） 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客户服务热线：400-8888-666

（12） 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558305

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

（13） 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（14） 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服电话：0731-84403350

公司网址：www.cfzq.com

（15） 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（16） 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

（17） 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

（18） 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

联系人：林生迎

客服电话：95565、400-8888-111

公司网址：www.newone.com.cn

(19) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：(0531) 68889155

传真：(0531) 68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(20) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：刘化军

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：梁旭

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(21) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-8202 3442

传真：0755-8202 6539

客服热线：400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

(22) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 20-25 楼

法定代表人：宫龙云

联系人：戴莉丽

电话：021-32229888-25122

传真：021-62878783

客服电话：021-63340678

公司网址：www.ajzq.com

(23) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701 邮编：100032

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层 邮编：100088

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045529

客服电话：010-66045678

传真：010-66045518

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

(24) 财富里昂证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

联系人：倪丹

电话：021-38784818

传真：021-68775878

客服热线：68777877

公司网址：www.cf-clsa.com

(25) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

联系人：吴琼

电话：0755—22621866

传真：0755—82400862

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

（26） 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

（27） 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（28） 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：021-53519888-1915

传真：021-33303353

客服电话：4008918918

公司网址：www.shzq.com

（29） 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

办公地址：广州市珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19、20 楼

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客服电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

（30） 长城国瑞证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：王勇

联系人：卢金文

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

客服热线：0592-5163588

公司网址：www.xmzq.com.cn

（31） 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服热线：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

（32） 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 层

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客服热线：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(33) 天源证券经纪有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼

法定代表人：林小明

联系人：聂晗

电话：0755-33331188

传真：0755-33329815

客服热线：4006543218

公司网址：www.tyzq.com.cn

(34) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 5 8 8 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 5 8 8 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

电话：0571-86078823

传真：0571-85783711

联系人：周妍

网址：www.bigsun.com.cn

客户服务电话：0571-96598

(35) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38600735

传真：021-38509777

客服热线：400—821—5399

公司网址：www.noah-fund.com

(36) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

法定代表人：洪家新

联系人：孔泉

电话：0755-82083788

传真：0755-82083408

客服热线：021-32109999, 029-68918888

网址：www.cfsc.com.cn

(37) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服热线：4006600109

公司网址：www.gjq.com.cn

(38) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

电话：0571-88911818 转 8565

传真：0571-86800423

客服热线：0571-88920897

公司网址：<http://www.ijijin.com.cn>

(39) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(40) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

电话：021-60897869

传真：0571-26698533

客服热线：4000 766 123

公司网址：www.fund123.cn

(41) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：于杨

电话：021-20835779

传真：021-20835885

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com>

(42) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

(43) 杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

办公地址：杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

电话：0571-85108195

传真：0571-85106576

客服热线：0571-96523 400-8888-508

公司网址：www.hzbank.com.cn

(44) 万联证券有限责任公司

注地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

电话：020-38286588

传真：020-38286588

客服电话：400-888-8133

公司网站：www.wljq.com.cn

（45）江苏银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市洪武北路 55 号

办公地址：江苏省南京市洪武北路 55 号

法定代表人：夏平

联系人：朱其龙

电话：86-25-58587112

传真：86-25-58588273

客服热线：40086-96098

公司网址：www.jsbchina.cn

（46）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

3. 场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：010-59378839

传真：010-59378907

联系人：朱立元

三、律师事务所和经办律师

名称：北京市君泽君律师事务所

住所：北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层

办公地址：北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层

负责人：王冰

电话：010-66523388

传真：010-66523399

经办律师：余红征、林袁袁

四、会计师事务所和经办注册会计师

名称：天衡会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座（14 幢）20 楼

办公地址：南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座（14 幢）20 楼

法定代表人：余瑞玉

经办注册会计师：谈建忠 魏娜

电话：025-84711188

传真：025-84716883

四、基金的名称

本基金名称：东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：债券型证券投资基金

六、基金的上市交易

本基金的可转债 A 份额与可转债 B 份额分别在深圳证券交易所上市交易。

七、基金的投资目标

本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制法的投资策略，按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调

整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括可转债（含分离交易可转债）、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证，须在达到可交易状态日起 10 个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略

本基金为债券指数基金，对指数投资部分，采用最优复制法的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪

在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在 0.5%以内，年跟踪误差控制在 5%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（一）资产配置策略

本基金将不低于基金资产净值的 80%投资于债券资产，又将不低于非现金基金资产的 80%投资于指数成份券及备选成份券。剩余资产将投资于流动性较好,收益较高的固定收益类产品,以保证投资组合能够在跟踪指数的基础上，具有较好的流动性。

（二）指数投资策略

对指数投资部分，采用优化复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。

1. 可转债投资组合的定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的标的指数对其成份券及成分券权重的调整而进行相应调整。

2. 可转债投资组合的不定期调整

当以下情况发生时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

(1) 本基金预期标的指数的成份券即将调整或权重发生变化；

(2) 成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例；

(3) 由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；

(4) 基金发生申购赎回、市场流动性变化等其他可能影响跟踪效果的情形。

3. 可转债投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，本基金将根据本基金的资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：

中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

十一、基金的风险收益特征

本基金是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。

从本基金的两类基金份额来看，可转债 A 份额为约定收益，将表现出预期低风险、预期收益相对稳定的明显特征；可转债 B 份额获得产品剩余收益，带有适当的杠杆效应，表现出预期风险高、预期收益高的显著特征。

十二、基金的投资组合报告

东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人平安股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2015年3月31日(未经审计)。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	754,126,192.80	93.50
	其中:债券	754,126,192.80	93.50
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	49,670,637.67	6.16
7	其他资产	2,786,130.48	0.35
8	合计	806,582,960.95	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	499,650.00	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,051.50	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	753,620,791.50	99.04
8	其他	1,699.80	0.00

9	合计	754,126,192.80	99.11
---	----	----------------	-------

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	1,738,090	238,587,614.30	31.36
2	110029	浙能转债	895,690	124,850,229.10	16.41
3	113008	电气转债	698,690	97,006,119.60	12.75
4	113501	洛钼转债	451,850	79,123,453.50	10.40
5	128009	歌尔转债	237,884	39,198,525.52	5.15

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	363,472.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	816,506.53
5	应收申购款	1,606,151.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,786,130.48

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	------	---------	-----------

				(%)
1	110023	民生转债	238,587,614.30	31.36
2	125089	深机转债	28,241,375.54	3.71
3	110028	冠城转债	27,415,112.10	3.60
4	113007	吉视转债	24,322,394.70	3.20
5	110011	歌华转债	22,087,083.20	2.90
6	113006	深燃转债	20,353,422.00	2.67
7	110012	海运转债	10,798,488.50	1.42
8	128008	奇峰转债	9,108,129.32	1.20
9	128006	长青转债	8,728,301.40	1.15
10	128005	齐翔转债	3,227,421.56	0.42
11	110019	恒丰转债	2,534,493.00	0.33
12	128007	通鼎转债	1,301,336.00	0.17
13	126729	燕京转债	679,209.24	0.09
14	128002	东华转债	81,955.72	0.01

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1. 东吴中证可转换债券基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

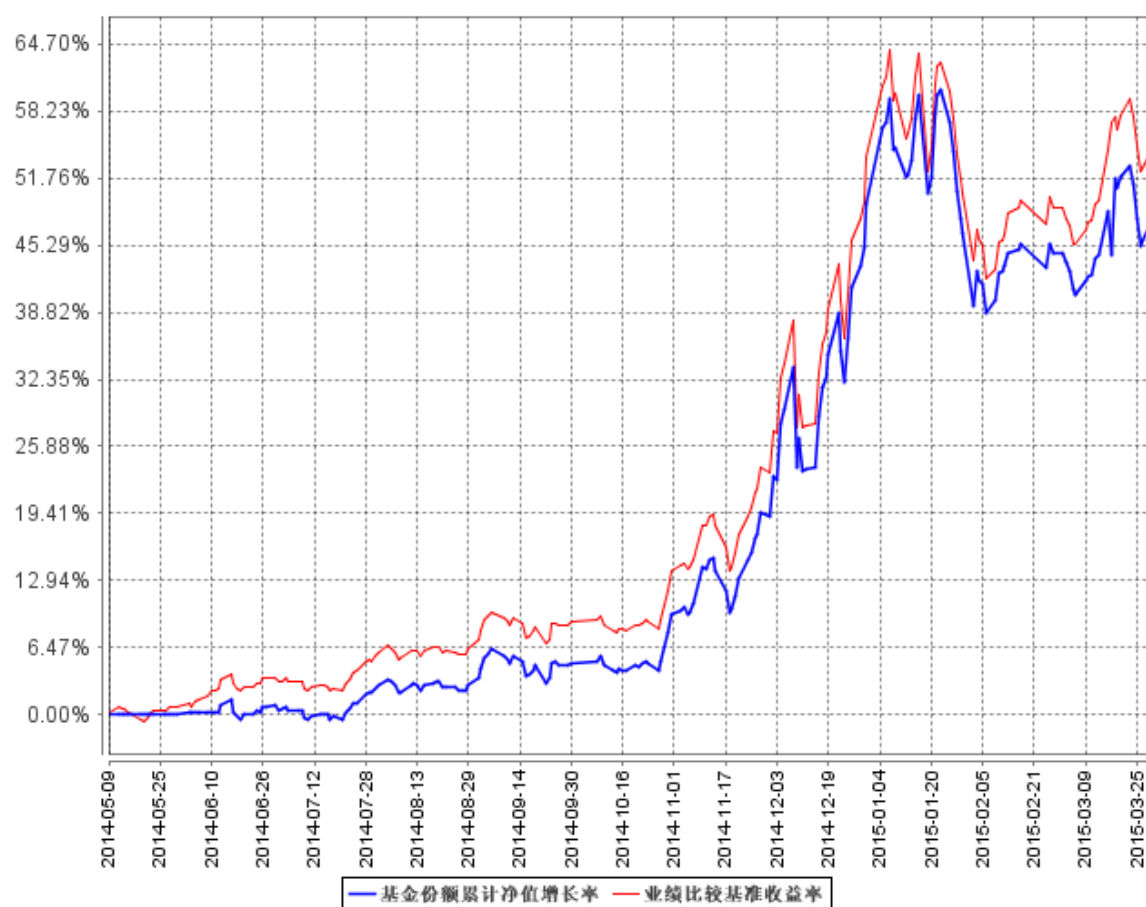
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.05.09-2014.12.31	49.22%	1.21%	53.77%	1.19%	-4.55%	0.02%
2015.01.01-2015.03.31	-2.14%	1.87%	-0.56%	1.85%	-1.58%	0.02%
2014.05.09-2015.03.31	45.52%	1.41%	52.90%	1.39%	-7.38%	0.02%

注：本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

2. 东吴中证可转换债券基金累计净值增长率历史走势图

自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较(2014年5月9日至2015年3月31日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金业绩比较基准=中证可转换债券指数收益率×95%+银行税后活期存款利率×5%

2、本基金于2014年5月9日成立。

十四、费用概览

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数使用许可费；
- 4、基金上市费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金的证券交易或结算而产生的费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.70\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数使用许可费

指数使用许可费根据基金管理人与指数开发商签署的相关许可协议确定并调整。在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.015% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.015\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费，E 为前一日的基金资产净值。

指数使用许可费每日计提，按季支付。指数使用许可费的收取下限为每季度人民币贰万伍仟元，基金设立当年，不足三个月的，按照三个月收费。

基金管理人可根据指数许可协议规定的费率、收费方式变更和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

上述“一、基金费用的种类中第 3—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、与基金销售有关的费用：东吴转债份额申购费率、赎回费率

1、申购费率

本基金对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减，最高申购费率不超过5%。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。基金的申购费率如下：

申购金额（M，含申购费）	申购费率
M < 10 万元	0.5%
10 万元 ≤ M < 100 万元	0.4%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.2%
M ≥ 200 万元	按笔收取，每笔 1000 元

申购费用由投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

2、赎回费率

本基金赎回费用按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定，基金的赎回费率如下：

	持有期限（N，持有时间）	赎回费率
场外赎回费	N < 3 个月	0.50%
	3 个月 ≤ N < 1 年	0.30%
	1 年 ≤ N < 2 年	0.05%
	N ≥ 2 年	0
场内赎回费	本基金场内赎回费为固定值 0.50%，不按份额持有时间分段设置赎回费率	

（注：其中 1 个月为 30 天，3 个月为 90 天；1 年为 365 日，2 年为 730 日）

东吴转债份额的场内赎回费率为固定值 0.5%。

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定

期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5、办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”中，更新了相关内容。
- 2、在“三、基金管理人”中，更新了相关内容。
- 3、在“四、基金托管人”中，更新了相关内容。
- 4、在“五、相关服务机构”中，更新了相关内容。
- 5、在“十、基金的投资”中，更新了相关内容。
- 6、在“十一、基金的业绩”中，更新了相关内容。
- 7、在“二十三、其他应披露事项”中，更新了其他披露事项：

(1) 2014年11月19日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告》；

(2) 2014年11月26日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》；

(3) 2014年11月27日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告》；

(4) 2014 年 12 月 2 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间可转债 A 份额停复牌的公告》；

(5) 2014 年 12 月 2 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金之可转债 A 份额本次定期折算期间约定年基准收益率的公告》；

(6) 2014 年 12 月 3 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》；

(7) 2014 年 12 月 3 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴可转债 A 份额折算后复牌首日收盘价调整的风险提示公告》；

(8) 2014 年 12 月 23 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金更新招募说明书及摘要》；

(9) 2014 年 12 月 23 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告》；

(10) 2014 年 12 月 29 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告》；

(11) 2014 年 12 月 30 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告》；

(12) 2014 年 12 月 31 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间可转债 A 份额、可转债 B 份额停复牌的公告》；

(13) 2015 年 1 月 5 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》；

(14) 2015 年 1 月 5 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《关于可转债 A 和可转债 B 不定期份额折算前后收盘价调整的公告》；

(15) 2015 年 1 月 5 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金 2014 年年度资产净值公告》；

(16) 2015 年 1 月 21 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告》；

(17) 2015 年 3 月 5 日在上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增国金证券股份有限公司为代销机构并推出转换业务的公告》；

(18) 2015 年 3 月 19 日在上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增江苏银行股份有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

(19) 2015 年 3 月 21 日在上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于变更江苏银行股份有限公司上线代销旗下基金并推出定期定额业务及转换业务时间的公告》；

(20) 2015 年 3 月 25 日在上海证券报、中国证券报、证券日报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法变更的公告》；

(21) 2015 年 3 月 28 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 2014 年年度报告以及摘要》；

(22) 2015 年 3 月 28 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告》；

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2015年6月19日签署。

东吴基金管理有限公司

二零一五年六月十九日